

第七届全国期货实盘赛 量化基金经理选拔赛 联合主办: 期货日报 webstock 文华财经 比赛时间: 2013年12月2日—2014年3月7日 大赛官方网址: http://spds.qhrb.com.cn 参赛选手交流群: 290890876

赛事点评

出比进更重要

周二,上证指数延续跌势继续下挫,尾盘收于2150附近,日内跌幅0.45%。股指期货主力合约IF1312较前一交易日结算价低开0.4点,日内振荡下行,波动区间为20.8点,波动幅度为0.88%。若下行趋势不改,后市可关注2300整数位支撑情况。

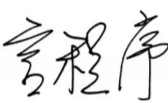
商品期货多数保持振荡行情,建议多关注日内量化交易机会。农产品方面,豆粕、菜粕双双跳空高开,主力合约日内涨幅均为1.04%,但双粕趋势性仍不明确,且昨日波动性不高,介入机会有限。贵金属方面,白银期货从日线级别来看仍处于较微妙的整理区间,但其波动性较强。昨日AG1406在凌晨快速冲高后有回落,午后再次攀升达到日内高点4272,涨幅高达2.33%,日内存在较好的介入机会。

我们认为,进场只是决定入场,而非入场。决定入场的关键是出场。出场的方法有很多种,这里列出几个大的方向,剩余的要靠读者自己去寻找了。

1.止损 当你的系统出现亏损,且已经达到你能忍受的限度,这时候就要承认失败,了结亏损。止损不仅仅是为了保护资金,也是为了保障你的获利,因为它能让你在市场上得到更多的交易机会。

2.止盈 简单来说就是到达获利满足点,将利润锁定,落袋为安,而不是纸上富贵,把原先赚的都吐出去。有可能是采取固定点止损,或者是跟踪止损出场等方式。

3.反手 你的系统是直接多空对翻,没有止损止盈,这种方法的好处是在回测过程中不会有过度最优化的嫌疑。我们在构建系统时只要加入止损或是止盈就会使绩效提升,但止盈止损点数的太小设置对系统绩效的影响很大,这些都需要交易者纳入考虑范围。



交易团队

TOP50 排行榜

Table with 15 columns: 排名, 赢智账号, 当日权益, 昵称, 综合得分, 日收益率, 累计净值, 净值得分, 历史最大回撤率, 回撤率得分, 累计净利润, 净利润得分, 胜率, 盈亏比, 手续费和净利润之比, 风险度, 操作指导, 持仓. Lists top 50 trading accounts.

行情(12月17日)

上海期货交易所主力合约行情

Table showing Shanghai Futures Exchange main contract prices for various commodities like copper, aluminum, zinc, etc.

上海期货交易所各品种日间均价

Table showing daily average prices for various commodities on the Shanghai Futures Exchange.

注:其他合约参考价格请登录上海期货交易所网站查询。

上期所有色金属期货价格指数

Table showing price indices for various non-ferrous metal futures.

大连商品交易所主力合约行情

Table showing Dalian Commodity Exchange main contract prices for soybeans, corn, etc.

郑州商品交易所主力合约行情

Table showing Zhengzhou Commodity Exchange main contract prices for cotton, sugar, etc.

易盛农产品期货价格系列指数(郑商所)

Table showing price indices for agricultural futures on the Zhengzhou Commodity Exchange.

中国金融期货交易所行情

Table showing China Financial Futures Exchange prices for interest rate and index futures.

各品种持仓及仓单变动

Table showing changes in open interest and warehouse receipts for various commodities.

注:持仓数据来源于持仓排名前20会员,上期所、中金所品种持仓为持仓合约。

商品现货参考报价(单位:元/吨)

Table showing commodity spot reference prices for various goods.

各品种持仓及仓单变动

Table showing changes in open interest and warehouse receipts for various commodities.

Table showing changes in open interest and warehouse receipts for various commodities.

主力合约排行榜

Table showing top trading volume contracts for various commodities.

涨幅榜

Table showing commodities with the largest price increases.

跌幅榜

Table showing commodities with the largest price decreases.

成交榜

Table showing top trading volume contracts for various commodities.

增仓榜

Table showing commodities with the largest increase in open interest.

减仓榜

Table showing commodities with the largest decrease in open interest.